



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: agosto de 2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA	100,00%
------------	---------

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,34	1,21	24.373.148,07	100,00	7.025.686.891,77	0,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,35	0,34	1,21	24.373.148,07	100,00		
Renda Fixa			0,35	0,34	1,21	24.373.148,07	100,00		
Total			0,35	0,34	1,21	24.373.148,07	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	24.373.148,07	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	24.373.148,07	100,00					100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,34 81,06	1,21 58,73	0,70 64,35	1,17 65,85	2,00 73,94	397.335,14	1.403.004,48
FUNAPREV (Total)						397.335,14	1.403.004,48

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.905.877,03	125.029.315,06	-124.959.379,16	0,00	24.373.148,07	397.335,14	1.403.004,48
					24.373.148,07	0,00	0,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/08/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

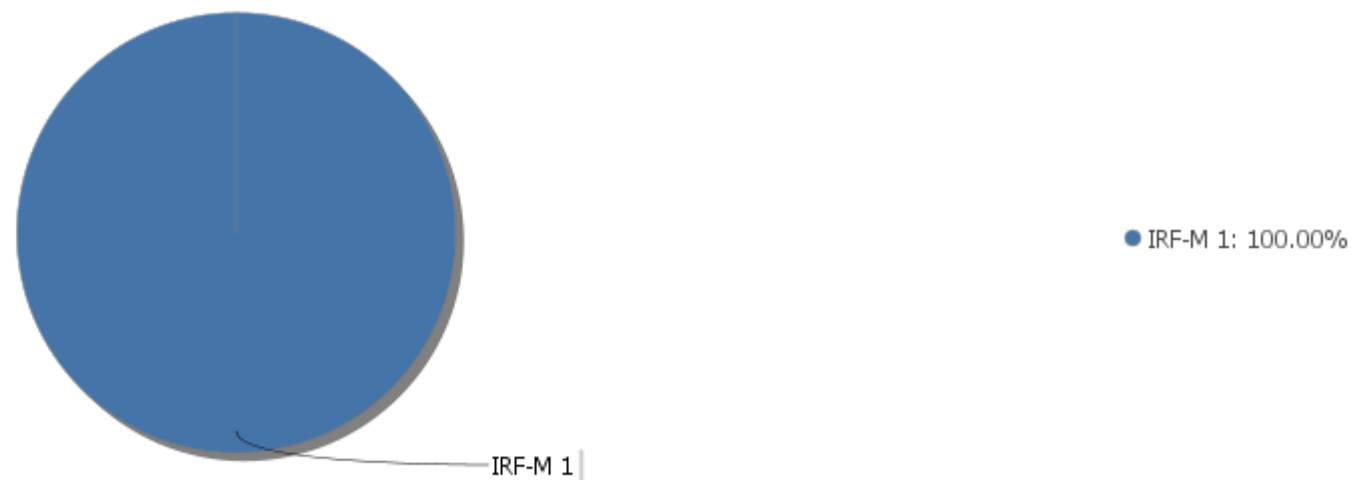
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	24.373.148,07	100,00	24.373.148,07	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	24.373.148,07	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	24.373.148,07	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

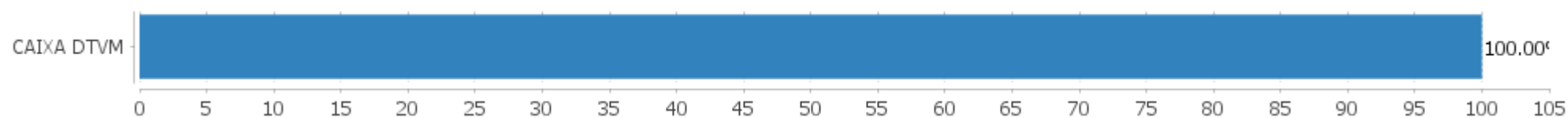


Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/08/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/08/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	0,03	0,02	0,01	0,28	0,17	0,19	0,17	0,34					1,21
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70	1,13	1,04					7,07
p.p. indexador	-0,38	-0,98	-1,10	-0,19	-0,83	-0,51	-0,97	-0,70					-5,86
2020	0,42	0,36	0,59	0,43	0,39	0,26	0,24	0,10	0,13	0,14	0,22	0,28	3,63
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55	0,95	1,17	1,19	1,68	8,42
p.p. indexador	-0,11	-0,15	0,20	0,45	0,48	-0,31	-0,46	-0,45	-0,82	-1,03	-0,97	-1,39	-4,79

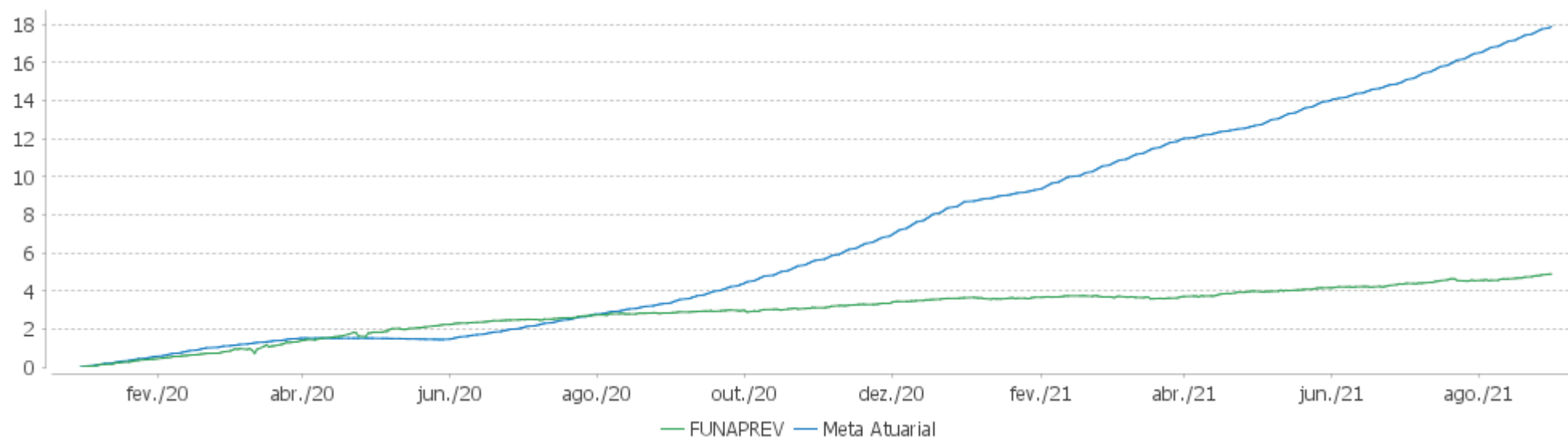
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

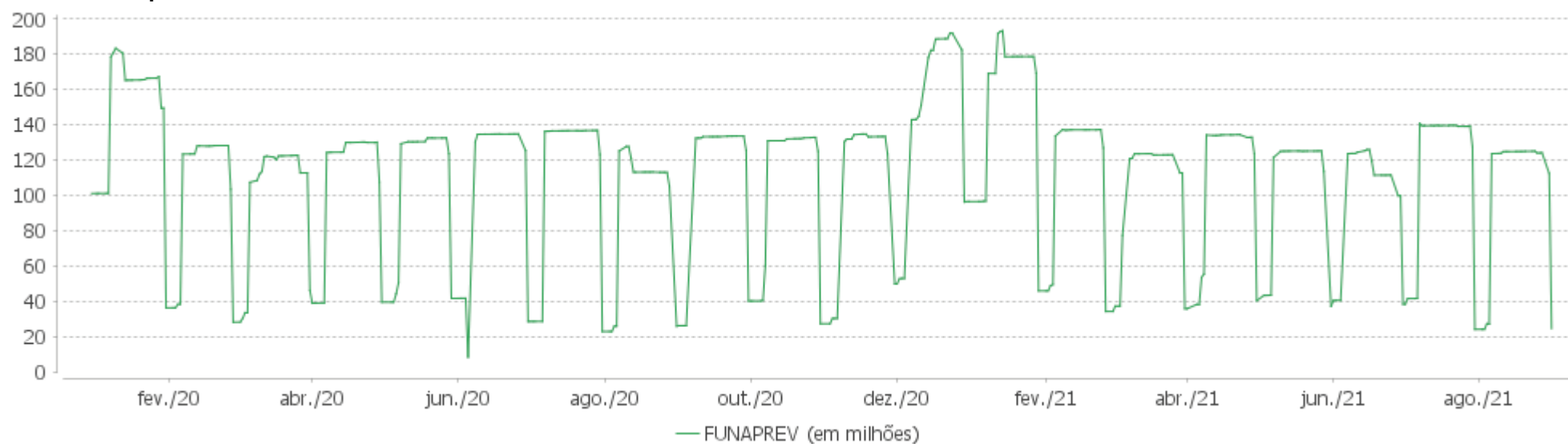
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	3	15,00	03 meses	0,70	2,90	-2,20	0,38
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	85,00	06 meses	1,17	5,58	-4,41	0,38
			12 meses	2,00	12,50	-10,50	0,35
			24 meses				
Desde 31/12/2019				4,88	16,09	-11,20	0,49
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03					
Menor rentabilidade da Carteira	0,01	2021-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

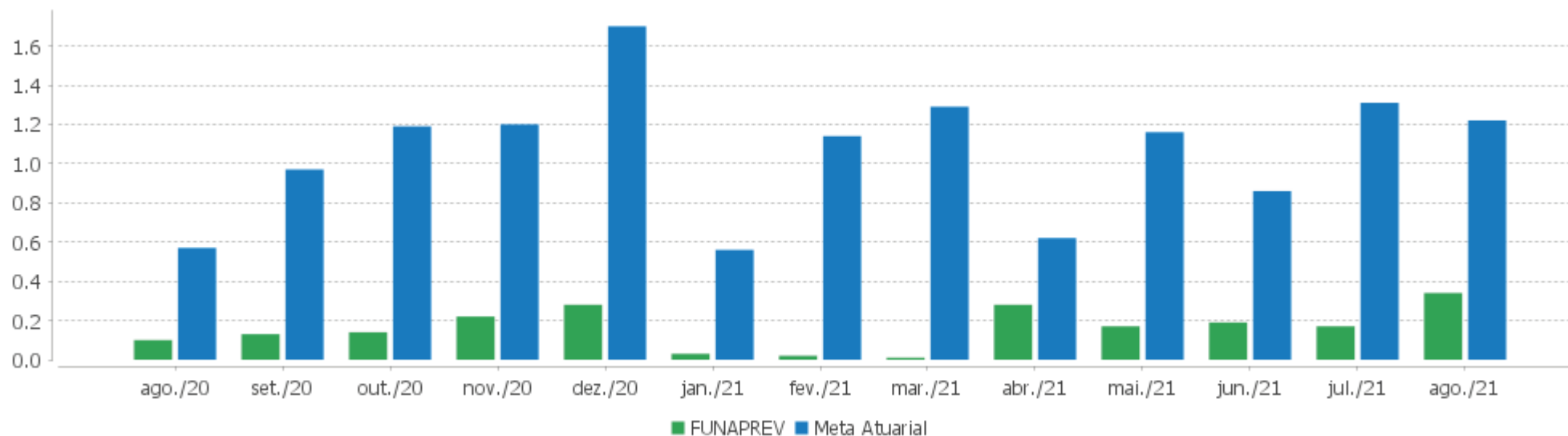


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/08/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,34 -0,02	1,21 -0,16	0,70 -0,07	1,17 -0,12	2,00 -0,24	6,95 -0,46	14,68 -0,67
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,34 -0,70	1,21 -5,86	0,70 -2,20	1,17 -4,41	2,00 -9,87		
CDI	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38
IBOVESPA	-2,48	-0,20	-5,89	7,95	19,54	17,45	54,91
INPC + 6,00%	1,39	10,11	4,07	7,96	17,02	27,69	39,70
IPCA + 6,00%	1,38	9,83	3,93	7,68	16,23	26,21	38,28

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/08/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/08/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,37	1,37	0,77	1,29	2,24	7,41	15,36	23,32	39,53
IRF-M 1+	-1,11	-5,18	-1,73	-1,87	-3,32	6,96	28,83	35,92	63,00
IRF-M TOTAL	-0,60	-2,63	-0,86	-0,67	-1,25	7,35	25,24	32,67	56,55
IMA-B 5	0,15	1,47	0,05	1,97	4,77	14,45	30,97	39,69	59,11
IMA-B 5+	-2,22	-5,44	-2,16	-1,52	1,80	6,60	47,32	51,19	76,06
IMA-B TOTAL	-1,09	-2,17	-1,04	0,19	3,27	10,12	40,44	46,85	69,60
IMA-GERAL TOTAL	-0,41	-0,37	-0,16	0,57	1,87	8,50	25,67	33,36	53,41
IDKA 2	0,26	1,95	-0,23	2,29	5,08	15,28	29,79	40,22	60,31
IDKA 20	-4,42	-9,21	-4,78	-4,01	0,70	0,45	60,91	59,85	88,93
CDI	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38	21,14	35,76

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,48	-0,20	-5,89	7,95	19,54	17,45	54,91	67,69	105,15
IBRX 100	-3,25	1,07	-6,53	7,96	20,88	19,52	61,19	73,03	111,89
IBRX 50	-3,50	1,23	-6,61	8,25	22,12	19,45	54,17	67,38	104,18
SMALL CAP	-3,82	0,95	-8,23	6,49	16,98	24,03	87,36	82,99	149,92
IFIX	-2,63	-4,19	-2,37	-4,74	-1,16	3,51	28,53	31,95	55,61
Índice Consumo - ICON	-3,90	-5,90	-8,34	0,65	0,42	6,20	60,80	43,37	64,23
Índice Dividendos - IDIV	-0,50	-0,20	-4,33	10,92	19,40	15,05	72,87	73,37	131,37

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/08/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,87	5,67	2,38	4,51	9,68	12,35	16,21	21,08	24,05
INPC	0,88	5,94	2,52	4,79	10,42	13,67	17,40	21,68	23,78
IGPM	0,66	16,75	2,06	11,01	31,12	48,19	55,53	69,35	66,46
SELIC	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38	21,15	35,79

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,34	19,17	5,75	10,37	21,46	92,07	93,87	199,05	230,68
MSCI ACWI	2,79	13,52	2,42	4,91	19,14	80,33	76,32	153,23	182,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,22	8,46	3,42	6,63	14,05	21,50	30,63	41,51	50,76
IPCA + 5,00%	1,30	9,15	3,67	7,15	15,14	23,85	34,42	47,00	58,11
IPCA + 5,50%	1,34	9,49	3,80	7,41	15,69	25,03	36,34	49,80	61,89
IPCA + 5,89%	1,38	9,76	3,90	7,62	16,11	25,95	37,85	52,02	64,89
IPCA + 6,00%	1,38	9,83	3,93	7,68	16,23	26,21	38,28	52,65	65,74
INPC + 4,00%	1,23	8,73	3,56	6,92	14,82	22,92	31,98	42,21	50,44
INPC + 6,00%	1,39	10,11	4,07	7,96	17,02	27,69	39,70	53,40	65,38

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/08/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
983	02/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.115,15530396	2,6361530000
984	03/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.603,60	0,00	2.125,57329901	2,6362770000
985	04/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.695,89	0,00	643,13655592	2,6369050000
1001	04/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.171.210,26	0,00	1.202.625,90423200	2,6369050000
1002	05/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	110.122,56	41.780,28682400	2,6357540000
986	06/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.010,87	0,00	5.314,68290079	2,6362570000
1003	06/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	117.492.074,09	0,00	44.567.761,82671100	2,6362570000
1004	06/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.014.949,30	7.971.510,09654600	2,6362570000
1005	09/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	103.223,20	0,00	39.155,25590400	2,6362540000
987	10/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	82.968,40	0,00	31.455,65092312	2,6376310000
1006	10/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.539,94	0,00	4.754,24348500	2,6376310000
988	11/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	158.677,86	0,00	60.150,22596441	2,6380260000
1007	11/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	697.715,16	0,00	264.483,80721000	2,6380260000
1008	11/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	473,27	179,40307800	2,6380260000
989	12/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.719,83	0,00	2.926,43271369	2,6379660000
990	13/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.564,84	0,00	2.488,56803964	2,6379990000
991	18/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.880,25	0,00	1.849,20084892	2,6391130000
992	18/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.460,01	1.311,05034154	2,6391130000
1009	18/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	62.033,73	0,00	23.505,52249900	2,6391130000
1010	18/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	60.333,41	22.861,24545700	2,6391130000
993	20/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.232,12	0,00	3.117,66514825	2,6404760000
1011	20/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.357,00	0,00	3.543,67924500	2,6404760000
994	23/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.640,67	0,00	13.116,81540181	2,6409360000
995	24/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.152,31	0,00	9.141,82208801	2,6419580000
996	25/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.018,40	0,00	3.791,70022466	2,6421920000
997	25/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.625,84	3.264,65298510	2,6421920000
1012	25/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	76.650,40	0,00	29.010,15520400	2,6421920000
1013	25/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.173.472,60	444.128,43689400	2,6421920000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/08/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
998	26/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.399,89	0,00	4.692,44887456	2,6425200000
1014	26/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.422,74	0,00	538,40273600	2,6425200000
999	27/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	93.767,15	0,00	35.474,87343934	2,6431990000
1000	30/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	58.091,45	0,00	21.969,88434803	2,6441400000
1015	30/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.619.135,46	0,00	612.348,61240300	2,6441400000
1016	30/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.479.962,22	5.098.051,62007800	2,6441400000
1017	31/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.257.589,83	0,00	475.525,81268400	2,6446300000
1018	31/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	89.107.979,95	33.693.930,70112900	2,6446300000
Total			125.029.315,06	124.959.379,16		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%Value-At-Risk (R\$): 40.701,87Value-At-Risk: 0,17%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,17	0,17			24.373.148,07	100,00

Renda FixaValue-At-Risk: 0,17%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,17	0,17	0,01			24.373.148,07	100,00
Sub-total	0,31	0,17	0,17		-0,26	0,34	24.373.148,07	100,00